

万家中证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	万家中证 2000 指数增强	
基金主代码	019920	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 21 日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	25,128,959.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	019920	019921
报告期末下属分级 基金的份额总额	13,325,834.05 份	11,803,125.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数的基础上实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强投资策略，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。具体策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）指数化投资策略；（2）指数增强策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、公开发行的证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）国债期货投资策略；（3）股票期权投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数增强型股票基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰剑	任航
	联系电话	021-38909626	010-66060069
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008880800	95599
传真		021-38909627	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦 电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区浦电路 360 号陆 家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、16 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200122	100031
法定代表人		方一天	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	http://www.wjasset.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	万家基金管理有限公司	上海市浦东新区浦电路 360 号 陆家嘴投资大厦 9 楼、15 楼、 16 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	5,407,051.87	3,996,311.49
本期利润	6,096,330.15	3,968,322.89
加权平均基金份 额本期利润	0.1116	0.1020
本期加权平均净 值利润率	11.00%	10.04%
本期基金份额净	13.73%	13.52%

值增长率		
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,828,985.84	1,595,242.24
期末可供分配基金份额利润	0.1373	0.1352
期末基金资产净值	15,154,819.89	13,398,367.24
期末基金份额净值	1.1373	1.1352
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	13.73%	13.52%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同生效于 2025 年 1 月 21 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

万家中证 2000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.88%	1.09%	6.08%	1.10%	1.80%	-0.01%
过去三个月	12.15%	1.99%	7.31%	2.02%	4.84%	-0.03%
自基金合同生效起至今	13.73%	1.62%	13.96%	1.79%	-0.23%	-0.17%

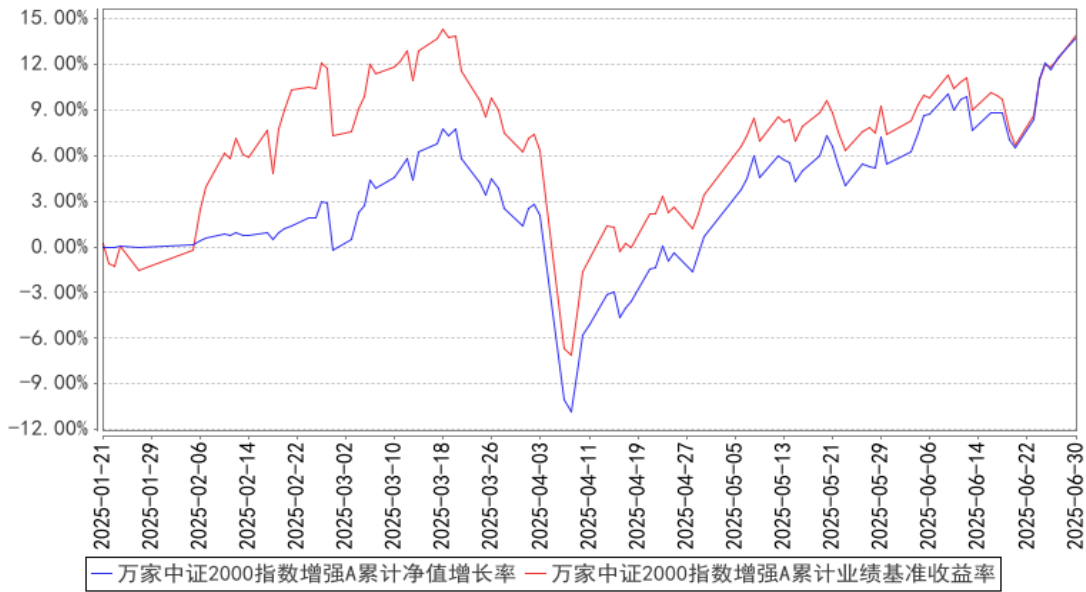
万家中证 2000 指数增强 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

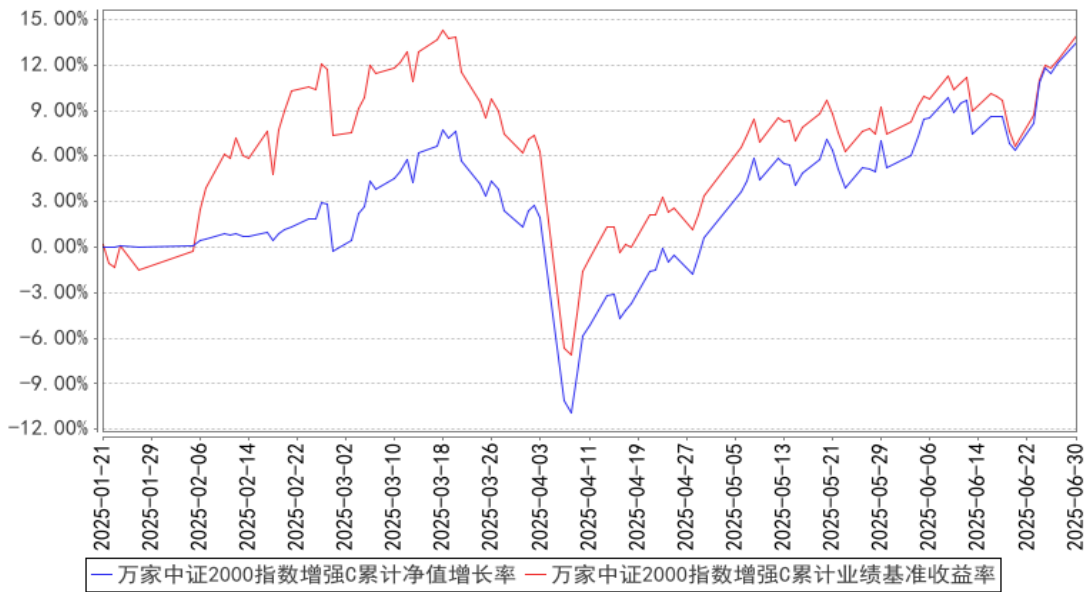
	率①	准差②		④		
过去一个月	7.84%	1.09%	6.08%	1.10%	1.76%	-0.01%
过去三个月	12.04%	1.99%	7.31%	2.02%	4.73%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	13.52%	1.62%	13.96%	1.79%	-0.44%	-0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万家中证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



万家中证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日期为 2025 年 1 月 21 日，基金合同生效未满一年。
2、根据基金合同规定，基金合同生效后六个月内为建仓期。截至报告期末本基金尚处于建仓

期。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44 号文批准设立。公司的股东为中泰证券股份有限公司、山东省新动能基金管理有限公司，住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 楼（名义楼层 9 层）。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 173 只开放式基金，其中包括 42 只股票型基金、73 只混合型基金、41 只债券型基金、5 只货币市场基金、4 只 QDII 基金、8 只基金中基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张永强	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、万家兴恒回报一年持有期混合型证券投资基金、万家创业板指数增强型证券投资基金、万家惠利债券型证券投资基金、万家招瑞回报一年持有期混合型证券投资基金、万家民丰回报一年持有期混合	2025 年 1 月 21 日	-	10 年	国籍：中国；学历：复旦大学基础数学专业硕士，2019 月 7 月入职万家基金管理有限公司，现任量化投资部基金经理，历任量化投资部研究员、投资经理。曾任上海恒生聚源数据服务有限公司研发中心指标算法研究员，上海元普投资管理有限公司量化投资部量化策略研究员，上海寻乾资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员，巨杉(上海)资产管理有限公司量化投资部量化策略研究员等职。

	型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				
乔亮	公司领导，首席量化投资官；万家上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、万家中证 2000 指数增强型证券投资基金、万家中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、万家元贞量化选股股票型证券投资基金、万家创业板指数增强型	2025 年 1 月 21 日	-	18.5 年	国籍：中国；学历：美国斯坦福大学工商管理博士，2019 年 7 月入职万家基金管理有限公司，现任公司首席量化投资官、基金经理，历任公司总经理助理、量化投资部总监（兼）、副总经理。曾任美国巴克莱国际投资管理公司投资部基金经理，加拿大退休基金国际投资管理公司量化投资部基金经理，南方基金管理有限公司数量化投资部投资经理，通联数据股份公司联合创始人、首席投资官，上海寻乾资产管理有限公司投资总监、总经理，巨杉（上海）资产管理有限公司量化投资部投资总监等职。

证券投资基金、万 家 国 证 2000 指 数 增 强 型 证 券 投 资 基 金、万 家 瑞 债 券 型 证 券 投 资 基 金、万 家 沪 深 300 指 数 增 强 型 证 券 投 资 基 金、万 家 量 化 睿 选 灵 活 配 置 混 合 型 证 券 投 资 基 金、万 家 颐 达 灵 活 配 置 混 合 型 证 券 投 资 基 金 的 基 金 经 理。				
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，管理人制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了研究、授权、投资决策

和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

管理人制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，原则上按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，为量化投资组合或不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金采用量化多因子选股策略，控制行业权重偏离度、个股集中度，通过量化多因子选股的方式选取一篮子股票组合。在行业和风格配置相对于业绩基准指数相对均衡，无重仓行业或具体风格，在量化选股方面精选行业内质优个股组合，持股较为分散。采用量化风险模型合理控制组合风险，保证较小的跟踪误差，投资目标是获取在既定跟踪误差下的超额收益最大化。本基金股票组合中 80% 以上权重为中证 2000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末万家中证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1373 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.73%，同期业绩比较基准收益率为 13.96%；截至本报告期末万家中证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1352 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.52%，同期业绩比较基准收益率为 13.96%。基金报告期内 A 份额、C 份额日均跟踪偏离度分别为 0.3752%、0.3750%，年

跟踪误差分别为 9.8831%、9.8817%，报告期内该基金处于建仓期。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，A 股市场虽有波折，但整体呈现震荡上行走势，年初至 1 月中旬受风险情绪压制快速下跌，春节之后至 3 月中旬，以 Deepseek 引领 TMT 板块走出“中国资产价值重估”行情，四月上旬受美国“对等关税”政策影响，A 股单日大幅下挫，但随后得益于政策维稳以及中美大幅调降关税，市场风险偏好提升，主要宽基指数稳步上涨，6 月末在金融股带动下进一步走强，上证指数创出年内新高。

展望后市，7 月政治局会议更加强调存量政策的落地，弱化增量预期，落实与细化存量的确定性更高，会议指出，“当前我国经济运行依然面临不少风险挑战，要正确把握形势，增强忧患意识，坚持底线思维，用好发展机遇、潜力和优势，巩固拓展经济回升向好势头”，因此对于下半年的经济工作，会议强调要“保持政策连续性稳定性，增强灵活性预见性，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期，有力促进国内国际双循环。从 5 月份关税纠纷缓和以来，A 股各板块“轮动上涨、低位补涨”的特征明显，赚钱效应的持续性更好，同时市场增量资金来源较为广泛，在低利率市场环境下以及资产配置荒格局下，后续“居民配置资金入市与股市慢涨”的正反馈效应也有望加强，A 股市场有望震荡上行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自 2025 年 3 月 31 日至 2025 年 6 月 30 日连续 61 个工作日基金资产净值低于五千万元。管理人已经将该基金情况向监管部门报告并提出解决方案，目前管理人正积极加强营销，力争扩大本基金规模。

本报告期内，本基金的基金份额持有人数量不存在低于二百人的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—万家基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，万家基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，万家基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：万家中证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	1,893,041.11
结算备付金		334,389.48

存出保证金		47,122.32
交易性金融资产	6.4.7.2	26,728,418.96
其中：股票投资		26,728,418.96
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		250,025.94
应收股利		-
应收申购款		68,336.32
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		29,321,334.13
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		609,917.32
应付管理人报酬		19,332.69
应付托管费		3,624.85
应付销售服务费		4,507.90
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	130,764.24
负债合计		768,147.00
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	25,128,959.05
其他综合收益	6.4.7.8	-
未分配利润	6.4.7.9	3,424,228.08

净资产合计		28,553,187.13
负债和净资产总计		29,321,334.13

注：1、报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 25,128,959.05 份，其中万家中证 2000 指数增强 A 基金份额净值 1.1373 元，基金份额总额 13,325,834.05 份；万家中证 2000 指数增强 C 基金份额净值 1.1352 元，基金份额总额 11,803,125.00 份。

2、本基金基金合同生效日为 2025 年 1 月 21 日，无上年度末对比数据。

6.2 利润表

会计主体：万家中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,631,865.91
1. 利息收入		356,467.52
其中：存款利息收入	6.4.7.10	170,890.92
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		185,576.60
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,908,457.17
其中：股票投资收益	6.4.7.11	8,725,631.58
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	985.64
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	181,839.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	661,289.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	705,651.54
减：二、营业总支出		567,212.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	355,085.91
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,578.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	73,347.55

4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	-
7. 税金及附加		668. 08
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	71, 532. 73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10, 064, 653. 04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10, 064, 653. 04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		10, 064, 653. 04

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金合同生效日为 2025 年 1 月 21 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：万家中证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	291, 585, 062. 79	-	-	291, 585, 062. 79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-266, 456, 103. 7 4	-	3, 424, 228. 08	-263, 031, 875. 66
（一）、综合收益总额	-	-	10, 064, 653. 04	10, 064, 653. 04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-266, 456, 103. 7 4	-	-6, 640, 424. 96	-273, 096, 528. 70

其中：1. 基金申购款	19,954,782.44	-	359,988.73	20,314,771.17
2. 基金赎回款	-286,410,886.18	-	-7,000,413.69	-293,411,299.87
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	25,128,959.05	-	3,424,228.08	28,553,187.13

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

2、本基金合同生效日为 2025 年 1 月 21 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

方一天

基金管理人负责人

陈广益

主管会计工作负责人

尹超

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

万家中证 2000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]2363 号文《关于准予万家中证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，并依据中国证监会机构司函[2024]1787 号文（《关于万家中证 2000 指数增强型证券投资基金延期募集备案的回函》由万家基金管理有限公司作为基金管理人于 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2025]第 ZA30024 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 1 月 21 日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 291,516,519.43 元，有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息为人民币 68,543.36 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 291,585,062.79

元，折合 291,585,062.79 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的证券公司短期公司债、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 2000 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产，包括货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以

发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，

基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通

受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(一)印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定,基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税;

根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定,自2023年8月28日起,证券交易印花税实施减半征收。

（二） 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(三) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(四) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》的规定，对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率

代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,893,041.11
等于：本金	1,892,826.29
加：应计利息	214.82
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,893,041.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		26,067,129.28	-	26,728,418.96	661,289.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		26,067,129.28	-	26,728,418.96	661,289.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	616.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	61,450.61
其中：交易所市场	61,450.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	68,696.82
合计	130,764.24

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

万家中证 2000 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	182,094,953.22	182,094,953.22
本期申购	8,394,313.99	8,394,313.99
本期赎回（以“-”号填列）	-177,163,433.16	-177,163,433.16
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	13,325,834.05	13,325,834.05

万家中证 2000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	109,490,109.57	109,490,109.57
本期申购	11,560,468.45	11,560,468.45

本期赎回（以“-”号填列）	-109,247,453.02	-109,247,453.02
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	11,803,125.00	11,803,125.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

万家中证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	5,407,051.87	689,278.28	6,096,330.15
本期基金份额交易产生的变动数	-3,366,743.85	-900,600.46	-4,267,344.31
其中：基金申购款	718,265.04	-779,469.10	-61,204.06
基金赎回款	-4,085,008.89	-121,131.36	-4,206,140.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,040,308.02	-211,322.18	1,828,985.84

万家中证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,996,311.49	-27,988.60	3,968,322.89
本期基金份额交易产生的变动数	-2,213,546.73	-159,533.92	-2,373,080.65
其中：基金申购款	858,746.67	-437,553.88	421,192.79
基金赎回款	-3,072,293.40	278,019.96	-2,794,273.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,782,764.76	-187,522.52	1,595,242.24

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	169,705.14
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,139.78
其他	46.00
合计	170,890.92

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月21日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,725,631.58
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,725,631.58

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	307,432,515.97
减：卖出股票成本总额	298,388,856.22
减：交易费用	318,028.17
买卖股票差价收入	8,725,631.58

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月21日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	457.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	528.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	985.64

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月21日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	600,331.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	598,164.00
减：应计利息总额	1,639.89
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	528.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月21日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	181,839.95
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	181,839.95

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月21日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	661,289.68
股票投资	661,289.68
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	661,289.68

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	705,314.94
基金转换费收入	336.60
合计	705,651.54

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	13,739.68
信息披露费	54,957.14
证券出借违约金	-
银行费用	2,835.91
合计	71,532.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司（“万家基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------------	-----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	355,085.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	173,413.27
应支付基金管理人的净管理费	181,672.64

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一

致后，向基金托管人发送基金管理费划款指令。基金管理人可选择在次月首日起 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,578.60

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，向基金托管人发送基金托管费划款指令。基金管理人可选择在次月首日起 3 个工作日内向基金托管人出具划款指令，也可授权基金托管人进行费用自动支付处理，如选择自动支付，基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足或其他原因造成自动支付无法进行，管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C	合计
农业银行	-	68,624.21	68,624.21
万家基金	-	4.54	4.54
中泰证券	-	431.80	431.80
合计	-	69,060.55	69,060.55

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。销

售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，由基金管理人根据相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期
	2025 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
农业银行	1, 893, 041. 11	169, 705. 14

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，存款按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6. 4. 10. 7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方所承销的证券。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6. 4. 10. 8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度可比期间数据。

6. 4. 11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6. 4. 12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6. 4. 12. 1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

6. 4. 12. 2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000633	合金投资	2025 年 6 月 24 日	重大事件停牌	6. 15	2025 年 7 月 1 日	6. 77	4, 000	24, 400. 00	24, 600. 00	-

6. 4. 12. 3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6. 4. 12. 3. 1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6. 4. 12. 3. 2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入各业务层面，建立了四道防线：以各岗位目标责任制为基础，形成第一道防线；合规风控部门通过完善的风险控制制度和手段对各一线部门的风险管理工作进行指导、管理和监督，形成第二道防线；独立的监察稽核部门对公司内部控制制度的总体执行情况和有效性进行监督、检查、评估和反馈，形成第三道防线；董事会及其风险管理委员会听取公司管理层对公司整体运营情况的报告，并提出指导性意见，形成第四道防线。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公

允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金资产的流动性风险进行管理，基金管理人建立了健全的流动性风险管理的内部控制体系，在申购赎回确认、投资交易、估值和信息披露等运作过程中专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，维护投资者的合法权益，公平对待投资者。本基金开放期间管理人对组合持仓集中度、短期变现能力、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本基金所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 6.4.12 “期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本基金未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现基金资产以支付赎回款的情况。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,893,041.11	-	-	-	-	-	1,893,041.11
结算备付金	334,389.48	-	-	-	-	-	334,389.48
存出保证金	47,122.32	-	-	-	-	-	47,122.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	26,728,418.96	26,728,418.96
应收申购款	0.38	-	-	-	-	68,335.94	68,336.32

应收清算款	-	-	-	-	-	250,025.94	250,025.94
资产总计	2,274,553.29	-	-	-	-	27,046,780.84	29,321,334.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	609,917.32	609,917.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,332.69	19,332.69
应付托管费	-	-	-	-	-	3,624.85	3,624.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,507.90	4,507.90
其他负债	-	-	-	-	-	130,764.24	130,764.24
负债总计	-	-	-	-	-	768,147.00	768,147.00
利率敏感度缺口	2,274,553.29	-	-	-	-	-26,278,633.84	28,553,187.13

注：1、该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早进行了分类。

2、本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	26,728,418.96	93.61
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	26,728,418.96	93.61

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票基准指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2025年6月30日）
	股票基准指数上升100个基点	254,105.81
	股票基准指数下降100个基点	-254,105.81

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日
第一层次	26,703,818.96
第二层次	24,600.00
第三层次	-
合计	26,728,418.96

注：本基金为本报告期内合同生效的基金，无上年度末对比数据。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产以及其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	26,728,418.96	91.16
	其中：股票	26,728,418.96	91.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,227,430.59	7.60
8	其他各项资产	365,484.58	1.25
9	合计	29,321,334.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	169,033.00	0.59
B	采矿业	113,322.00	0.40
C	制造业	15,858,793.56	55.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	479,395.00	1.68
E	建筑业	192,669.00	0.67
F	批发和零售业	1,561,052.00	5.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,963,815.40	6.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	301,076.00	1.05
L	租赁和商务服务业	298,327.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	513,041.00	1.80
N	水利、环境和公共设施管理业	59,136.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	180,432.00	0.63
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	241,306.00	0.85
S	综合	-	-
	合计	21,931,397.96	76.81

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	158,877.00	0.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,550,987.60	8.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,688.00	0.18
E	建筑业	53,220.00	0.19
F	批发和零售业	403,514.00	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	101,643.00	0.36

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	775,946.00	2.72
J	金融业	212,699.00	0.74
K	房地产业	108,138.00	0.38
L	租赁和商务服务业	103,761.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	67,590.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	52,214.40	0.18
R	文化、体育和娱乐业	157,743.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	4,797,021.00	16.80

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601886	江河集团	21,500	132,225.00	0.46
2	000823	超声电子	11,100	131,535.00	0.46
3	605277	新亚电子	7,200	129,312.00	0.45
4	300081	恒信东方	18,200	128,856.00	0.45
5	600668	尖峰集团	9,100	128,765.00	0.45
6	002284	亚太股份	11,600	128,180.00	0.45
7	002483	润邦股份	20,500	128,125.00	0.45
8	002296	辉煌科技	11,400	127,110.00	0.45
9	300231	银信科技	10,300	126,793.00	0.44
10	002523	天桥起重	34,600	126,290.00	0.44
11	300420	五洋自控	36,600	125,904.00	0.44
12	300288	朗玛信息	8,200	123,902.00	0.43
13	002725	跃岭股份	9,400	123,892.00	0.43
14	002469	三维化学	14,900	123,819.00	0.43
15	688722	同益中	5,800	123,366.00	0.43
16	000551	创元科技	9,600	123,360.00	0.43
17	600351	亚宝药业	20,300	123,221.00	0.43

18	600262	北方股份	5,400	123,120.00	0.43
19	300349	金卡智能	10,300	123,085.00	0.43
20	600268	国电南自	15,700	122,774.00	0.43
21	600336	澳柯玛	18,000	122,760.00	0.43
22	000601	韶能股份	25,200	122,472.00	0.43
23	002419	天虹股份	22,800	122,208.00	0.43
24	688238	和元生物	19,700	122,140.00	0.43
25	600237	铜峰电子	16,800	121,800.00	0.43
26	300239	东宝生物	20,500	121,565.00	0.43
27	300421	力星股份	8,100	121,338.00	0.42
28	002362	汉王科技	5,400	121,068.00	0.42
29	002783	凯龙股份	14,000	120,820.00	0.42
30	002587	奥拓电子	18,700	120,615.00	0.42
31	688360	德马科技	6,500	120,575.00	0.42
32	300249	依米康	8,800	120,032.00	0.42
33	002843	泰嘉股份	5,400	119,826.00	0.42
34	300507	苏奥传感	15,600	119,808.00	0.42
35	300219	鸿利智汇	17,800	119,616.00	0.42
36	600103	青山纸业	53,800	119,436.00	0.42
37	300543	朗科智能	11,100	119,325.00	0.42
38	603660	苏州科达	16,500	119,295.00	0.42
39	000404	长虹华意	16,800	119,280.00	0.42
40	002452	长高电新	17,100	118,845.00	0.42
41	603933	睿能科技	6,900	118,818.00	0.42
42	002479	富春环保	23,700	118,737.00	0.42
43	600626	申达股份	32,700	118,701.00	0.42
44	300018	中元股份	14,900	118,455.00	0.41
45	300667	必创科技	7,500	118,425.00	0.41
46	603566	普莱柯	8,700	118,407.00	0.41
47	002442	龙星科技	18,500	118,030.00	0.41
48	603966	法兰泰克	12,700	117,856.00	0.41
49	000659	珠海中富	39,800	117,808.00	0.41
50	000779	甘咨询	12,700	117,729.00	0.41
51	601116	三江购物	10,800	117,612.00	0.41
52	002659	凯文教育	23,300	117,432.00	0.41
53	002953	日丰股份	11,300	117,294.00	0.41
54	002686	亿利达	18,000	117,180.00	0.41
55	603629	利通电子	5,200	117,000.00	0.41
56	002054	德美化工	17,000	116,960.00	0.41
57	601616	广电电气	30,200	116,874.00	0.41
58	605080	浙江自然	4,200	116,760.00	0.41
59	301017	漱玉平民	9,100	116,753.00	0.41
60	300105	龙源技术	15,100	116,421.00	0.41

61	300110	华仁药业	35,900	115,957.00	0.41
62	300279	和晶科技	16,700	115,731.00	0.41
63	000955	欣龙控股	24,600	115,620.00	0.40
64	002863	今飞凯达	22,800	115,596.00	0.40
65	600071	凤凰光学	5,400	115,344.00	0.40
66	001207	联科科技	4,700	115,338.00	0.40
67	002404	嘉欣丝绸	17,800	115,166.00	0.40
68	002695	煌上煌	12,200	114,680.00	0.40
69	603070	万控智造	8,600	114,294.00	0.40
70	000705	浙江震元	13,500	114,075.00	0.40
71	603116	红蜻蜓	19,400	114,072.00	0.40
72	603085	天成自控	9,900	113,949.00	0.40
73	301060	兰卫医学	11,800	113,870.00	0.40
74	603600	永艺股份	10,700	113,848.00	0.40
75	300956	英力股份	7,000	113,540.00	0.40
76	002576	通达动力	6,900	113,505.00	0.40
77	003025	思进智能	8,380	113,465.20	0.40
78	603206	嘉环科技	6,600	113,388.00	0.40
79	002441	众业达	12,500	113,375.00	0.40
80	600758	辽宁能源	30,300	113,322.00	0.40
81	603617	君禾股份	15,800	113,286.00	0.40
82	600429	三元股份	25,100	113,201.00	0.40
83	002999	天禾股份	16,200	113,076.00	0.40
84	603329	上海雅仕	10,000	112,500.00	0.39
85	603628	清源股份	9,200	112,332.00	0.39
86	603708	家家悦	11,000	112,200.00	0.39
87	002772	众兴菌业	14,300	111,683.00	0.39
88	600785	新华百货	9,500	111,435.00	0.39
89	605068	明新旭腾	6,200	111,414.00	0.39
90	603278	大业股份	12,200	111,020.00	0.39
91	002905	金逸影视	11,900	110,432.00	0.39
92	300452	山河药辅	9,000	110,430.00	0.39
93	605228	神通科技	10,000	109,900.00	0.38
94	002825	纳尔股份	11,000	109,780.00	0.38
95	600410	华胜天成	11,300	108,367.00	0.38
96	605218	伟时电子	4,800	107,424.00	0.38
97	301119	正强股份	2,900	102,544.00	0.36
98	301367	瑞迈特	1,200	100,920.00	0.35
99	002286	保龄宝	8,600	97,438.00	0.34
100	688381	帝奥微	4,400	95,304.00	0.33
101	002455	百川股份	11,700	87,516.00	0.31
102	300932	三友联众	7,600	87,020.00	0.30
103	300980	祥源新材	3,700	86,654.00	0.30

104	688595	芯海科技	2,300	85,997.00	0.30
105	688685	迈信林	1,500	83,775.00	0.29
106	300656	民德电子	3,100	82,863.00	0.29
107	603499	翔港科技	4,680	77,173.20	0.27
108	600619	海立股份	6,600	75,306.00	0.26
109	688636	智明达	2,184	73,797.36	0.26
110	300203	聚光科技	3,300	73,029.00	0.26
111	300019	硅宝科技	3,600	71,064.00	0.25
112	300697	电工合金	4,800	69,264.00	0.24
113	688668	鼎通科技	1,100	68,706.00	0.24
114	300662	科锐国际	2,300	68,333.00	0.24
115	688095	福昕软件	1,000	67,910.00	0.24
116	688258	卓易信息	1,400	67,802.00	0.24
117	300499	高澜股份	3,800	67,640.00	0.24
118	002102	能特科技	21,400	67,624.00	0.24
119	300825	阿尔特	6,200	67,022.00	0.23
120	688103	国力股份	1,100	66,924.00	0.23
121	300278	华昌达	12,100	66,066.00	0.23
121	301033	迈普医学	1,100	66,066.00	0.23
122	688261	东微半导	1,600	66,000.00	0.23
123	688401	路维光电	1,900	65,930.00	0.23
124	600226	亨通股份	23,600	65,844.00	0.23
125	603818	曲美家居	12,800	65,792.00	0.23
126	300322	硕贝德	4,400	65,780.00	0.23
127	688181	八亿时空	2,100	65,352.00	0.23
128	688031	星环科技	1,400	65,282.00	0.23
129	603950	长源东谷	2,600	65,078.00	0.23
130	300990	同飞股份	1,300	64,870.00	0.23
131	300652	雷迪克	1,100	64,779.00	0.23
132	000925	众合科技	8,400	64,512.00	0.23
133	605305	中际联合	2,300	63,894.00	0.22
134	688590	新致软件	3,100	63,674.00	0.22
135	688286	敏芯股份	900	63,621.00	0.22
136	000560	我爱我家	21,400	63,558.00	0.22
137	600495	晋西车轴	12,700	63,500.00	0.22
138	002297	博云新材	7,900	63,200.00	0.22
138	002560	通达股份	8,000	63,200.00	0.22
139	300145	南方泵业	18,000	63,000.00	0.22
139	300192	科德教育	4,200	63,000.00	0.22
140	002876	三利谱	2,500	62,975.00	0.22
141	300471	厚普股份	5,900	62,776.00	0.22
142	002169	智光电气	9,700	62,759.00	0.22
143	000042	中洲控股	8,800	62,568.00	0.22

144	688365	光云科技	4,100	62,402.00	0.22
145	688039	当虹科技	1,900	62,358.00	0.22
146	600476	湘邮科技	3,300	62,304.00	0.22
147	301248	杰创智能	2,500	62,200.00	0.22
148	688512	慧智微	5,700	62,187.00	0.22
149	000850	华茂股份	13,900	61,994.00	0.22
150	301230	泓博医药	1,800	61,956.00	0.22
151	688609	九联科技	5,900	61,773.00	0.22
152	601929	吉视传媒	34,100	61,721.00	0.22
153	002042	华孚时尚	13,500	61,560.00	0.22
154	688588	凌志软件	4,200	61,194.00	0.21
155	603703	盛洋科技	5,900	61,183.00	0.21
156	301260	格力博	3,100	61,132.00	0.21
157	600135	乐凯胶片	7,900	60,988.00	0.21
158	603520	司太立	6,200	60,760.00	0.21
159	603626	科森科技	7,200	60,624.00	0.21
160	300690	双一科技	2,500	60,525.00	0.21
161	002989	中天精装	1,800	60,444.00	0.21
162	003038	鑫铂股份	3,100	60,419.00	0.21
163	603938	三孚股份	4,200	60,396.00	0.21
164	300448	浩云科技	8,900	60,342.00	0.21
165	688173	希荻微	4,400	60,104.00	0.21
166	300510	金冠股份	13,100	59,998.00	0.21
167	600742	富维股份	6,300	59,913.00	0.21
168	300241	瑞丰光电	10,500	59,850.00	0.21
169	002346	柘中股份	4,400	59,840.00	0.21
170	600708	光明地产	17,400	59,682.00	0.21
171	002112	三变科技	4,600	59,570.00	0.21
172	000717	中南股份	24,400	59,536.00	0.21
173	002026	山东威达	4,900	59,535.00	0.21
174	002885	京泉华	4,200	59,430.00	0.21
175	002478	常宝股份	11,300	59,325.00	0.21
176	300365	恒华科技	9,000	59,310.00	0.21
177	603528	多伦科技	7,100	59,214.00	0.21
178	002669	康达新材	5,100	59,160.00	0.21
178	603890	春秋电子	5,100	59,160.00	0.21
179	000803	山高环能	9,600	59,136.00	0.21
180	300612	宣亚国际	3,900	58,890.00	0.21
181	300374	中铁装配	3,700	58,830.00	0.21
182	002462	嘉事堂	4,400	58,828.00	0.21
183	002285	世联行	25,800	58,824.00	0.21
183	002662	峰璟股份	17,200	58,824.00	0.21
184	300441	鲍斯股份	7,200	58,752.00	0.21

185	300230	永利股份	12,000	58,680.00	0.21
186	002454	松芝股份	7,600	58,672.00	0.21
187	000906	浙商中拓	9,200	58,604.00	0.21
188	002264	新华都	9,200	58,420.00	0.20
189	301220	亚香股份	1,300	58,370.00	0.20
190	600616	金枫酒业	10,300	58,298.00	0.20
191	002282	博深股份	7,800	58,266.00	0.20
192	603861	白云电器	5,900	58,233.00	0.20
193	300797	钢研纳克	4,200	58,212.00	0.20
194	603386	骏亚科技	4,600	58,190.00	0.20
195	002322	理工能科	4,800	58,080.00	0.20
196	601113	华鼎股份	14,700	58,065.00	0.20
197	300989	蕾奥规划	3,400	58,038.00	0.20
198	603901	永创智能	5,500	57,970.00	0.20
199	002722	物产金轮	3,600	57,924.00	0.20
200	300381	溢多利	7,700	57,904.00	0.20
201	300939	秋田微	1,900	57,760.00	0.20
202	300788	中信出版	1,800	57,744.00	0.20
203	300206	理邦仪器	4,800	57,696.00	0.20
204	000993	闽东电力	5,900	57,643.00	0.20
205	002631	德尔未来	12,300	57,564.00	0.20
206	603105	芯能科技	7,000	57,540.00	0.20
207	002646	天佑德酒	6,200	57,536.00	0.20
208	301489	思泉新材	1,000	57,490.00	0.20
209	300592	华凯易佰	5,100	57,375.00	0.20
210	300967	晓鸣股份	3,100	57,350.00	0.20
211	603081	大丰实业	5,300	57,346.00	0.20
212	000920	沃顿科技	5,300	57,240.00	0.20
213	002728	特一药业	6,800	57,188.00	0.20
214	000421	南京公用	8,700	57,159.00	0.20
215	002758	浙农股份	6,400	57,152.00	0.20
216	300720	海川智能	2,600	56,940.00	0.20
217	000419	通程控股	10,000	56,900.00	0.20
218	300583	赛托生物	3,300	56,892.00	0.20
219	300891	惠云钛业	5,900	56,758.00	0.20
220	000570	苏常柴 A	9,800	56,742.00	0.20
221	000715	中兴商业	9,900	56,727.00	0.20
222	002578	闽发铝业	16,900	56,615.00	0.20
223	000045	深纺织 A	5,100	56,559.00	0.20
224	300701	森霸传感	5,400	56,484.00	0.20
225	002016	世荣兆业	10,300	56,444.00	0.20
226	603518	锦泓集团	5,700	56,316.00	0.20
227	603101	汇嘉时代	7,500	56,250.00	0.20

228	002548	金新农	14,800	56,240.00	0.20
229	600479	千金药业	5,400	56,160.00	0.20
230	002661	克明食品	5,600	56,056.00	0.20
231	300534	陇神戎发	5,800	56,028.00	0.20
232	605166	聚合顺	5,000	55,950.00	0.20
233	603739	蔚蓝生物	4,200	55,944.00	0.20
234	603618	杭电股份	9,100	55,510.00	0.19
235	600222	太龙药业	9,900	55,341.00	0.19
236	300648	星云股份	1,600	55,296.00	0.19
237	300011	鼎汉技术	7,400	55,278.00	0.19
238	301256	华融化学	5,200	55,068.00	0.19
239	300824	北鼎股份	4,600	54,878.00	0.19
240	603006	联明股份	4,500	54,810.00	0.19
241	600822	上海物贸	5,500	54,725.00	0.19
242	002732	燕塘乳业	3,300	54,351.00	0.19
243	301116	益客食品	4,900	54,145.00	0.19
244	300996	普联软件	3,580	53,807.40	0.19
245	301025	读客文化	4,800	52,800.00	0.18
246	002937	兴瑞科技	3,100	51,522.00	0.18
247	300831	派瑞股份	3,500	51,205.00	0.18
248	300193	佳士科技	5,600	50,680.00	0.18
249	300572	安车检测	2,400	50,400.00	0.18
250	300154	瑞凌股份	5,400	48,600.00	0.17
251	003002	壶化股份	1,700	47,838.00	0.17
252	600386	北巴传媒	8,500	38,845.00	0.14
253	002598	山东章鼓	3,400	37,808.00	0.13
254	300608	思特奇	3,200	37,248.00	0.13
255	002218	拓日新能	11,400	36,936.00	0.13
256	300341	麦克奥迪	2,200	35,596.00	0.12
257	002915	中欣氟材	1,900	33,972.00	0.12
258	600527	江南高纤	16,100	33,327.00	0.12
259	301028	东亚机械	2,700	33,183.00	0.12
260	600215	派斯林	3,700	28,046.00	0.10
261	002009	天奇股份	1,800	27,702.00	0.10
262	002912	中新赛克	1,100	26,235.00	0.09
263	603998	方盛制药	2,600	25,532.00	0.09
264	000677	恒天海龙	3,800	21,470.00	0.08
265	688222	成都先导	1,300	20,904.00	0.07
266	600880	博瑞传播	3,800	20,330.00	0.07
267	600628	新世界	2,700	19,764.00	0.07
268	600191	华资实业	2,600	19,084.00	0.07
269	603586	金麒麟	1,000	18,320.00	0.06
270	002090	金智科技	1,800	17,244.00	0.06

271	002111	威海广泰	1,600	17,168.00	0.06
272	301007	德迈仕	500	15,495.00	0.05
273	300320	海达股份	1,500	14,910.00	0.05
274	603135	中重科技	1,400	13,888.00	0.05
275	603777	来伊份	900	11,817.00	0.04
276	001338	永顺泰	900	10,728.00	0.04
277	301185	鸥玛软件	500	9,785.00	0.03
278	003020	立方制药	400	8,928.00	0.03
279	603067	振华股份	420	6,400.80	0.02
280	603357	设计总院	600	5,196.00	0.02
281	603191	望变电气	200	2,524.00	0.01
282	300404	博济医药	200	1,844.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688655	迅捷兴	5,500	116,545.00	0.41
2	002897	意华股份	2,800	108,612.00	0.38
3	000573	粤宏远 A	26,900	108,138.00	0.38
4	301069	凯盛新材	6,700	107,937.00	0.38
5	600097	开创国际	10,300	107,532.00	0.38
6	300150	世纪瑞尔	21,400	107,428.00	0.38
7	002774	快意电梯	12,100	106,359.00	0.37
8	600793	宜宾纸业	4,100	105,657.00	0.37
9	002909	集泰股份	16,800	104,832.00	0.37
10	300295	三六五网	6,500	104,520.00	0.37
11	603682	锦和商管	18,300	103,761.00	0.36
12	000757	浩物股份	22,700	102,831.00	0.36
13	300184	力源信息	10,000	98,200.00	0.34
14	300369	绿盟科技	12,500	97,125.00	0.34
15	600866	星湖科技	11,300	78,083.00	0.27
16	300401	花园生物	3,800	57,798.00	0.20
17	603089	正裕工业	4,400	57,508.00	0.20
18	002985	北摩高科	1,900	57,475.00	0.20
19	688128	中国电研	2,300	56,350.00	0.20
20	688262	国芯科技	2,100	56,007.00	0.20
21	300687	赛意信息	2,000	55,560.00	0.19
22	688288	鸿泉物联	1,900	55,119.00	0.19
23	300170	汉得信息	3,200	55,072.00	0.19
24	601375	中原证券	13,200	54,912.00	0.19
25	300768	迪普科技	3,200	54,880.00	0.19
26	605255	天普股份	2,800	54,768.00	0.19
27	603466	风语筑	5,400	54,486.00	0.19
28	688162	巨一科技	2,000	54,480.00	0.19

29	000818	航锦科技	2,400	54,000.00	0.19
30	600166	福田汽车	19,900	53,929.00	0.19
31	688280	精进电动	7,400	53,798.00	0.19
32	002926	华西证券	6,000	53,640.00	0.19
33	603286	日盈电子	1,800	53,604.00	0.19
34	600335	国机汽车	8,300	53,535.00	0.19
35	300609	汇纳科技	1,600	53,472.00	0.19
36	002761	浙江建投	6,000	53,220.00	0.19
37	002979	雷赛智能	1,200	53,136.00	0.19
38	002373	千方科技	5,700	53,010.00	0.19
39	603103	横店影视	3,300	52,965.00	0.19
40	000100	TCL 科技	12,200	52,826.00	0.19
41	301008	宏昌科技	2,300	52,716.00	0.18
42	000420	吉林化纤	13,500	52,650.00	0.18
43	000686	东北证券	6,900	52,647.00	0.18
44	688327	云从科技	3,800	52,402.00	0.18
45	600308	华泰股份	15,280	52,257.60	0.18
46	301239	普瑞眼科	1,332	52,214.40	0.18
47	603500	祥和实业	5,700	52,212.00	0.18
48	600299	安迪苏	5,400	52,110.00	0.18
49	000063	中兴通讯	1,600	51,984.00	0.18
50	300715	凯伦股份	5,200	51,532.00	0.18
51	300039	上海凯宝	8,500	51,510.00	0.18
52	001227	兰州银行	20,600	51,500.00	0.18
53	002697	红旗连锁	9,600	51,360.00	0.18
54	002234	民和股份	6,300	51,345.00	0.18
55	603326	我乐家居	6,200	51,336.00	0.18
56	300497	富祥药业	5,700	51,243.00	0.18
57	600037	歌华有线	6,700	51,188.00	0.18
58	688779	五矿新能	9,400	51,136.00	0.18
59	601333	广深铁路	17,600	50,864.00	0.18
60	601598	中国外运	10,300	50,779.00	0.18
61	301089	拓新药业	1,600	50,768.00	0.18
62	600746	江苏索普	6,500	50,765.00	0.18
63	002811	郑中设计	4,800	50,688.00	0.18
63	600163	中闽能源	9,900	50,688.00	0.18
64	002739	万达电影	4,400	50,292.00	0.18
65	600789	鲁抗医药	4,900	49,049.00	0.17
66	603299	苏盐井神	5,100	48,297.00	0.17
67	301066	万事利	3,000	46,740.00	0.16
68	300022	吉峰科技	5,200	45,968.00	0.16
69	000901	航天科技	3,500	43,505.00	0.15
70	002611	东方精工	3,100	37,386.00	0.13

71	300168	万达信息	4,600	35,282.00	0.12
72	603219	富佳股份	2,000	29,020.00	0.10
73	603696	安记食品	2,500	27,425.00	0.10
74	002727	一心堂	1,600	26,144.00	0.09
75	600712	南宁百货	4,400	25,476.00	0.09
76	000633	合金投资	4,000	24,600.00	0.09
77	300641	正丹股份	1,000	22,790.00	0.08
78	600418	江淮汽车	500	20,045.00	0.07
79	601038	一拖股份	1,300	16,991.00	0.06
80	301228	实朴检测	600	16,902.00	0.06
81	600073	光明肉业	2,100	15,498.00	0.05
82	301039	中集车辆	1,900	15,447.00	0.05
83	600815	厦工股份	5,000	13,650.00	0.05
84	603320	迪贝电气	700	12,691.00	0.04
85	603819	神力股份	800	10,728.00	0.04
86	300871	回盛生物	100	2,090.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600237	铜峰电子	1,183,958.00	4.15
2	601616	广电电气	1,145,826.00	4.01
3	002576	通达动力	969,587.00	3.40
4	688418	震有科技	954,983.98	3.34
5	300374	中铁装配	921,346.00	3.23
6	002362	汉王科技	902,315.00	3.16
7	002614	奥佳华	895,884.00	3.14
8	300745	欣锐科技	874,558.00	3.06
9	002579	中京电子	867,374.00	3.04
10	000823	超声电子	857,950.00	3.00
11	002562	兄弟科技	857,291.00	3.00
12	603586	金麒麟	819,997.00	2.87
13	002379	宏创控股	819,048.00	2.87
14	600619	海立股份	815,671.00	2.86
15	000925	众合科技	813,692.00	2.85
16	002296	辉煌科技	812,898.00	2.85
17	300684	中石科技	811,019.00	2.84
18	603600	永艺股份	807,293.00	2.83
19	002725	跃岭股份	798,879.00	2.80
20	002483	润邦股份	791,240.00	2.77
21	002769	普路通	784,193.00	2.75
22	300018	中元股份	776,943.00	2.72
23	688025	杰普特	773,073.62	2.71

24	300486	东杰智能	770,899.00	2.70
25	603499	翔港科技	765,836.00	2.68
26	603660	苏州科达	761,727.00	2.67
27	000850	华茂股份	758,174.00	2.66
28	002886	沃特股份	756,984.00	2.65
29	300162	雷曼光电	754,850.00	2.64
30	000659	珠海中富	750,508.00	2.63
31	600560	金自天正	750,131.00	2.63
32	002902	铭普光磁	749,929.00	2.63
33	603131	上海沪工	745,744.00	2.61
34	600523	贵航股份	740,403.00	2.59
35	300349	金卡智能	739,851.00	2.59
36	002474	榕基软件	739,191.00	2.59
37	300515	三德科技	738,827.00	2.59
38	300543	朗科智能	738,113.00	2.59
39	600178	东安动力	730,154.00	2.56
40	300975	商络电子	729,259.00	2.55
41	300120	经纬辉开	727,585.00	2.55
42	002795	永和智控	725,791.00	2.54
43	688518	联赢激光	720,655.60	2.52
44	300241	瑞丰光电	720,513.00	2.52
45	603527	众源新材	718,007.00	2.51
46	300228	富瑞特装	717,355.00	2.51
47	300510	金冠股份	715,879.00	2.51
48	002527	新时达	710,661.00	2.49
49	300690	双一科技	710,360.00	2.49
50	002676	顺威股份	704,693.00	2.47
51	300533	冰川网络	702,436.00	2.46
52	002264	新华都	700,923.00	2.45
53	300423	昇辉科技	700,033.00	2.45
54	000955	欣龙控股	696,199.00	2.44
55	002284	亚太股份	693,246.00	2.43
56	002782	可立克	692,523.00	2.43
57	300252	金信诺	687,670.00	2.41
58	000159	国际实业	685,981.00	2.40
59	603618	杭电股份	684,552.00	2.40
60	603933	睿能科技	682,402.00	2.39
61	002455	百川股份	680,941.00	2.38
62	002962	五方光电	679,014.00	2.38
63	603626	科森科技	677,474.00	2.37
64	688609	九联科技	676,031.32	2.37
65	600626	申达股份	670,109.00	2.35
66	603232	格尔软件	669,600.00	2.35

67	002298	中电鑫龙	669,020.00	2.34
68	002845	同兴达	667,189.00	2.34
69	300546	雄帝科技	665,703.00	2.33
70	002885	京泉华	665,285.00	2.33
71	000404	长虹华意	662,788.00	2.32
72	300560	中富通	659,465.00	2.31
73	300016	北陆药业	659,417.00	2.31
74	300637	扬帆新材	657,120.67	2.30
75	002367	康力电梯	656,799.00	2.30
76	603912	佳力图	656,349.00	2.30
77	002395	双象股份	652,737.00	2.29
78	688662	富信科技	648,212.14	2.27
79	300407	凯发电气	647,798.00	2.27
80	300708	聚灿光电	646,857.00	2.27
81	300149	睿智医药	646,646.00	2.26
82	300445	康斯特	645,900.00	2.26
83	600367	红星发展	645,875.00	2.26
84	301021	英诺激光	644,793.00	2.26
85	300279	和晶科技	644,602.00	2.26
86	002452	长高电新	637,599.00	2.23
87	600268	国电南自	635,711.00	2.23
88	002952	亚世光电	633,159.00	2.22
89	300890	翔丰华	629,750.00	2.21
90	300101	振芯科技	628,074.00	2.20
91	002792	通宇通讯	627,497.00	2.20
92	600071	凤凰光学	622,555.00	2.18
93	605286	同力日升	621,735.00	2.18
94	002469	三维化学	621,432.00	2.18
95	603081	大丰实业	620,397.00	2.17
96	000901	航天科技	619,643.00	2.17
97	300720	海川智能	617,946.00	2.16
98	603101	汇嘉时代	615,235.44	2.15
99	300609	汇纳科技	610,857.00	2.14
100	601116	三江购物	609,300.00	2.13
101	688252	天德钰	608,783.26	2.13
102	300940	南极光	606,927.00	2.13
103	600135	乐凯胶片	606,354.00	2.12
104	600386	北巴传媒	605,633.00	2.12
105	000421	南京公用	601,472.00	2.11
106	300047	天源迪科	599,940.00	2.10
107	002337	赛象科技	596,879.00	2.09
108	300578	会畅通讯	596,128.00	2.09
109	603776	永安行	595,333.00	2.08

110	002017	东信和平	594,983.00	2.08
111	000957	中通客车	591,848.00	2.07
112	603966	法兰泰克	589,624.00	2.07
113	300859	西域旅游	588,108.00	2.06
114	300369	绿盟科技	587,906.00	2.06
115	301058	中粮科工	586,507.00	2.05
116	000803	山高环能	586,257.00	2.05
117	688033	天宜新材	579,029.45	2.03
118	002073	软控股份	578,470.00	2.03
119	002772	众兴菌业	577,590.00	2.02
120	600351	亚宝药业	577,202.00	2.02
121	600880	博瑞传播	575,043.00	2.01
122	300375	鹏翎股份	574,661.00	2.01
123	300238	冠昊生物	574,551.00	2.01
124	688039	当虹科技	573,898.83	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600237	铜峰电子	1,081,876.00	3.79
2	601616	广电电气	1,077,802.00	3.77
3	300745	欣锐科技	991,647.00	3.47
4	002379	宏创控股	972,705.00	3.41
5	688418	震有科技	969,825.32	3.40
6	002614	奥佳华	951,361.00	3.33
7	002576	通达动力	924,576.00	3.24
8	300374	中铁装配	874,883.30	3.06
9	002562	兄弟科技	874,163.00	3.06
10	002579	中京电子	866,687.00	3.04
11	688025	杰普特	858,836.24	3.01
12	002769	普路通	854,370.00	2.99
13	603586	金麒麟	852,852.00	2.99
14	300486	东杰智能	841,594.00	2.95
15	600560	金自天正	837,515.00	2.93
16	300515	三德科技	836,259.00	2.93
17	600619	海立股份	835,794.00	2.93
18	002298	中电鑫龙	835,410.00	2.93
19	300684	中石科技	816,253.00	2.86
20	300533	冰川网络	801,431.00	2.81
21	000925	众合科技	793,892.00	2.78
22	002886	沃特股份	790,214.00	2.77
23	002362	汉王科技	777,293.00	2.72
24	300228	富瑞特装	773,694.00	2.71

25	603527	众源新材	767,179.00	2.69
26	002474	榕基软件	766,313.00	2.68
27	600523	贵航股份	765,472.00	2.68
28	300162	雷曼光电	764,072.00	2.68
29	600178	东安动力	762,257.00	2.67
30	300975	商络电子	759,824.00	2.66
31	300120	经纬辉开	759,170.00	2.66
32	002527	新时达	757,646.00	2.65
33	688662	富信科技	752,011.71	2.63
34	000823	超声电子	746,198.00	2.61
35	300423	昇辉科技	744,433.00	2.61
36	600367	红星发展	740,675.00	2.59
37	603912	佳力图	740,375.00	2.59
38	603131	上海沪工	737,518.00	2.58
39	300016	北陆药业	731,884.00	2.56
40	002676	顺威股份	730,756.00	2.56
41	002296	辉煌科技	730,548.00	2.56
42	300252	金信诺	727,621.00	2.55
43	002902	铭普光磁	726,418.00	2.54
44	002483	润邦股份	718,423.00	2.52
45	301021	英诺激光	717,806.00	2.51
46	688518	联赢激光	717,511.35	2.51
47	002725	跃岭股份	715,785.00	2.51
48	300510	金冠股份	715,770.00	2.51
49	002795	永和智控	714,243.00	2.50
50	300543	朗科智能	712,554.00	2.50
51	002093	国脉科技	708,483.00	2.48
52	000850	华茂股份	707,263.00	2.48
53	300149	睿智医药	705,288.00	2.47
54	002782	可立克	704,395.00	2.47
55	603232	格尔软件	695,509.00	2.44
56	300047	天源迪科	691,724.00	2.42
57	000159	国际实业	691,236.00	2.42
58	605066	天正电气	690,708.00	2.42
59	300101	振芯科技	690,427.00	2.42
60	002395	双象股份	686,900.00	2.41
61	300445	康斯特	679,724.00	2.38
62	300018	中元股份	677,221.00	2.37
63	002367	康力电梯	675,155.00	2.36
64	603626	科森科技	674,670.00	2.36
65	301058	中粮科工	674,030.00	2.36
66	300637	扬帆新材	672,450.00	2.36
67	300560	中富通	670,892.00	2.35

68	002962	五方光电	669,390.00	2.34
69	300690	双一科技	669,098.00	2.34
70	603600	永艺股份	664,286.00	2.33
71	300940	南极光	663,604.00	2.32
72	002885	京泉华	663,042.00	2.32
73	603660	苏州科达	662,713.00	2.32
74	002952	亚世光电	658,557.00	2.31
75	688609	九联科技	657,955.17	2.30
76	002264	新华都	655,945.00	2.30
77	300720	海川智能	654,611.00	2.29
78	002845	同兴达	651,515.00	2.28
79	603776	永安行	650,951.00	2.28
80	605286	同力日升	649,376.00	2.27
81	603499	翔港科技	649,357.00	2.27
82	300546	雄帝科技	646,284.00	2.26
83	000659	珠海中富	645,775.00	2.26
84	300241	瑞丰光电	644,753.00	2.26
85	603618	杭电股份	644,292.00	2.26
86	300708	聚灿光电	642,494.00	2.25
87	300407	凯发电气	642,120.00	2.25
88	003010	若羽臣	641,706.00	2.25
89	300859	西域旅游	636,591.00	2.23
90	300578	会畅通讯	629,813.00	2.21
91	300349	金卡智能	629,455.65	2.20
92	603079	圣达生物	624,167.20	2.19
93	002792	通宇通讯	623,709.00	2.18
94	300468	四方精创	623,004.00	2.18
95	002733	雄韬股份	620,447.00	2.17
96	002284	亚太股份	617,325.00	2.16
97	600722	金牛化工	616,711.00	2.16
98	301013	利和兴	615,285.00	2.15
99	600386	北巴传媒	609,938.00	2.14
100	002337	赛象科技	607,917.00	2.13
101	300375	鹏翎股份	605,593.00	2.12
102	300238	冠昊生物	605,251.00	2.12
103	000901	航天科技	605,178.49	2.12
104	300890	翔丰华	603,623.00	2.11
105	002632	道明光学	600,928.00	2.10
106	002455	百川股份	599,211.00	2.10
107	600829	人民同泰	598,898.00	2.10
108	000955	欣龙控股	597,828.00	2.09
109	002073	软控股份	596,262.00	2.09
110	300609	汇纳科技	594,052.00	2.08

111	688033	天宜新材	593,113.98	2.08
112	002975	博杰股份	590,797.00	2.07
113	688010	福光股份	589,008.23	2.06
114	603933	睿能科技	580,694.00	2.03
115	600988	赤峰黄金	580,155.00	2.03
116	300099	尤洛卡	575,794.00	2.02
117	000965	天保基建	575,637.00	2.02
118	002017	东信和平	572,948.00	2.01
119	603101	汇嘉时代	571,507.80	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	324,455,985.50
卖出股票收入（成交）总额	307,432,515.97

注：本项买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用；本项卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股指期货交易，利用股指期货剥离部分多头股票资产的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照风险管理的原则，同时基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	47,122.32
2	应收清算款	250,025.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	68,336.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	365,484.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
万家中证 2000 指数 增强 A	661	20,160.11	-	-	13,325,834.05	100.00
万家中证 2000 指数 增强 C	590	20,005.30	-	-	11,803,125.00	100.00
合计	1,195	21,028.42	-	-	25,128,959.05	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	万家中证 2000 指数增强 A	201,553.38	1.5125
	万家中证 2000 指数增强 C	-	-
	合计	201,553.38	0.8021

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门 负责人持有本开放式 基金	万家中证 2000 指数增强 A	10~50
	万家中证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有	万家中证 2000 指数增强 A	10~50

本开放式基金	万家中证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	万家中证 2000 指数增强 A	万家中证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 1 月 21 日) 基金份额总额	182,094,953.22	109,490,109.57
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	8,394,313.99	11,560,468.45
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	177,163,433.16	109,247,453.02
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	13,325,834.05	11,803,125.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：
报告期内, 本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：
2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。
2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。
2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自基金合同生效日起由立信会计师事务所（特殊普通合伙）为基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
银河证券	2	631,888,501.47	100.00	123,794.51	100.00	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

为加强证券投资基金交易费用管理，管理人特制定《证券投资基金交易费用管理办法》。依据该办法，管理人设立合作证券公司备选库，并按照业务类型进行分类管理。备选库具体分为被动股票型基金合作证券公司备选库和其他类型基金合作证券公司备选库。纳入备选库内的证券经营机构方可参与管理人基金产品的证券交易服务。

选择证券公司参与证券交易的标准如下：

- (1) 财务状况稳健：证券公司应具备良好的财务状况，经营行为符合相关法律法规及行业规范；
- (2) 内控与风控能力强：证券公司具备完善的内部控制制度，合规管理和风险控制能力较强；
- (3) 技术支持完善：具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需求；
- (4) 专业能力与服务水平：具有较强的研究能力及金融服务水平，或在交易服务、券商结算等业务方面具备较强能力。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

(1) 管理人从财务状况、研究服务能力、风险管理能力、合规管理能力、交易服务水平、交易信息技术能力等方面对证券公司进行评估考察，经内部审批完成后，最终确定入选合作证券公司的备选库。

(2) 与入选备选库证券公司达成合作意向后，双方签订协议，明确双方的权利义务，包括服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

3、基金专用交易席位的变更情况：

本基金为本报告期内成立的基金，上述席位均为新增交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
银河证券	1,196,856.00	100.00	332,000,000.00	100.00	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证	-	-	-	-	-	-

券						
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增苏州银行为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 3 日
2	关于新增中信银行股份有限公司为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 3 日
3	关于新增华鑫证券等机构为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 6 日
4	关于新增方正证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日

5	关于新增上海浦东发展银行股份有限公司为万家中证 2000 指数增强基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
6	关于新增中银国际证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
7	关于新增东方证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 8 日
8	关于新增东莞银行为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 9 日
9	关于新增上海证券为万家中证 2000 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定媒介	2025 年 1 月 13 日
10	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	指定媒介	2025 年 1 月 22 日
11	万家基金管理有限公司关于旗下部分基金在开源证券开通申购、转换、定投业务及参与其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 2 月 18 日
12	关于万家中证 2000 指数增强型证券投资基金开放申购、赎回、基金转换及定期定额投资业务的公告	指定媒介	2025 年 2 月 19 日
13	万家基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分基金销售机构并开通定投及参与费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 4 月 7 日
14	万家基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
15	万家中证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	指定媒介	2025 年 4 月 21 日
16	万家基金管理有限公司关于增加广发银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	指定媒介	2025 年 5 月 6 日
17	万家基金管理有限公司关于增加邮储银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务的公告	指定媒介	2025 年 5 月 17 日
18	万家基金管理有限公司关于增加宁波银行为旗下部分基金销售机构并开通定投业务的公告	指定媒介	2025 年 6 月 18 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
个人	1	20250520-20250527	8,000,333.33	-	8,000,333.33	-	-
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《万家中证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《万家中证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、万家中证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告原文。
- 5、万家基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 6、万家基金管理有限公司董事会决议。
- 7、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金净值、更新招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站：www.wjasset.com。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公场所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

万家基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日